

●資金需給

単位：億円	2017年9月4日 需給速報	2017年9月5日 需給予想	2017年9月6日 当社予想
銀行券	1,000	1,000	1,000
財政	▲ 28,100	▲ 2,300	▲ 1,000
資金過不足	▲ 27,100	▲ 1,300	0
金融調節	スタート	エンド	スタート
貸出			
全店共通	1,400	▲ 1,500	
国債買現			
国債売現			
国庫短期証買入		1,000	
国債買入		10,000	4,000
CP等買入		▲ 100	▲ 700
貸出支援基金(成)			
貸出支援基金(貸)			
被災地支援			
社債等買入		▲ 100	
E T F 買入	100	100	
国債補完供給	▲ 100	100	100
当預増減	▲ 27,300	9,200	4,000
当座預金残高	3,602,500	3,611,700	3,615,700
準備預金残高	3,207,500		
積み終了先	3,207,300		9月5日以降の残り所要積立額
超過準備	3,207,300		積数 1,400
非準備預金先	395,000		1日平均 100
積み期間 (8/16~9/15) の所要準備額			2,994,300
準備預金進捗率	実績	99.95%	日数 64.52%

●短期金融市場関連指標

2017/9/4	無担(速報)			有担(速報)			短国	東京 レポレート
単位：%	最低	最高	平均	最低	最高	平均	売買参考統計値	平均値
O/N	▲ 0.086	0.001	▲ 0.064				-	▲ 0.099
T/N			▲ 0.025				-	▲ 0.098
S/N							-	-
1W	▲ 0.045	0.230	▲ 0.034				-	▲ 0.102
2W			▲ 0.043				-	▲ 0.104
3W			▲ 0.040				-	▲ 0.104
1M							-	▲ 0.155
3M							▲ 0.223	▲ 0.124
6M							▲ 0.150	▲ 0.131
1Y							▲ 0.151	▲ 0.153

JGB新発10年債		日経平均株価		ドル/円	
直近値	前日比	15時時点	前日比	為替(9時)	為替(17時)
▲ 0.009	▲ 0.004	19,508.25	▲ 183.22	109.81-82	109.47-49
日付	8/28	8/29	8/30	8/31	9/1
日銀当預残	3,622,000	3,629,100	3,636,700	3,636,100	3,629,800
準備預金残	3,220,600	3,215,600	3,224,400	3,223,800	3,216,200
マネタリーベース	4,677,400	4,684,600	4,692,300	4,691,900	4,685,700
無担O/N加重平均	▲ 0.056%	▲ 0.057%	▲ 0.059%	▲ 0.066%	▲ 0.063%
コール市場残高	96,076	95,974	90,137	82,513	96,124
うち無担	73,642	73,153	67,048	62,336	71,731
うちO/N	47,807	46,968	42,753	40,451	47,616
うち有担	22,434	22,821	23,089	20,177	24,393

●入札結果

名称	回号	表面 利率	発行 予定額	発行日	償還日	応募額 (億円)	応募額 (億円)	募入 最低額	募入 最高利回	案分率	募入 平均価格	募入 平均利回	第1非価格 競争入札 (億円)
本日は財務省による国債等の入札は実施されませんでした。													

●オペ結果

種類	オファー額 (億円・ 百万ドル)	スタート日	エンド日	貸付 利率	応札総額 (億円・ 百万ドル)	落札総額 (億円・ 百万ドル)	按分レート ・利回較差 ・価格較差	全取レート ・利回較差 ・価格較差	平均落札レート ・利回較差 ・価格較差	按分 比率
国債買入(残存期間1年以下)	1,000	2017/9/6			2,509	1,002	0.001		0.012	45.8
国債買入(残存期間10年超25年以下)	2,000	2017/9/6			7,106	2,011	▲ 0.004		▲ 0.002	30.5
国債買入(残存期間25年超)	1,000	2017/9/6			3,939	1,007	▲ 0.004		▲ 0.003	93.7
国債補完供給(国債売現先)・即日(午前オファー分)	20,000	2017/9/4	2017/9/5		89	89		▲ 0.600	▲ 0.600	

●2017年9月5日の予定

*9月の日銀当座預金増減要因見込み	*米国7月の 製造業新規受注・出荷・在庫	*10年利付国債入札 (23,000億円、9/20発行)
-------------------	-------------------------	---------------------------------

◆本資料は信頼できるとされる各種データに基づいて作成されておりますが、当社はその正確性、完全性を保証するものではありません。

◆本資料は何らかの取引を誘引することを目的としたものではありません。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。

◆金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。

セントラル短資株式会社 登録金融機関関東財務局長（登金）第526号 日本証券業協会加入